

Fecha de Publicación: 24 de Diciembre de 2010
Fecha de Información: 22 de Diciembre de 2010 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$600,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -9,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,3	58,6	27,0	58,0	31,6	10,3	0,0
15-35	78,5	149,3	55,7	54,0	77,6	8,5	16,0
36-60	3,3	36,0	10,0	0,0	26,0	3,3	0,0
61-90	25,0	28,0	25,0	25,0	3,0	0,0	0,0
91-180	40,7	22,7	0,0	25,0	7,7	0,6	15,0
>180	37,0	53,0	25,0	10,0	3,0	2,0	25,0
Total	252,7	347,5	142,7	172,0	148,8	24,7	56,0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operacines con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	-8,4 %	-14,8 %	-12,4 %
15-35	-8,4 %	-13,5 %	-15,0 %	-13,5 %
36-60	-	-10,5 %	-10,4 %	-10,5 %
61-90	-	-0,5 %	0,0 %	-0,2 %
91-180	-3,7 %	-0,5 %	-3,7 %	-3,2 %
>180	-0,2 %	-0,6 %	-1,0 %	-0,5 %
Total	-3,5 %	-9,2 %	-10,8 %	-9,2 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	300	1744	1721	6	473	1924	1923	9	124	980	1316
Intragrupa y off-shore***	0	0	1217	1108	0	0	1156	1067	0	0	730	410
Otros	300	15	218	350	473	6	252	343	124	9	346	330
Total	315	315	3178	3178	479	479	3332	3332	133	133	2056	2056

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo